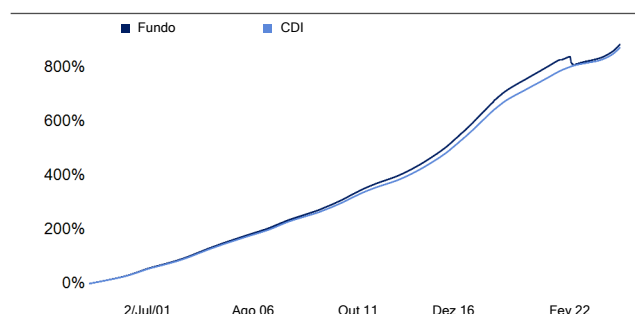
BTG Pactual Capital Markets FI RF

Renda Fixa

Rentabilidade (%) em R$

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Acum. Ano	Acum. Fundo
2018														
% Fundo	0,60	0,48	0,55	0,52	0,51	0,52	0,55	0,57	0,49	0,56	0,49	0,50	6,52	784,09
% CDI	103,04	102,69	104,20	100,69	98,52	99,99	101,21	100,57	103,74	102,74	99,66	100,70	101,52	105,41
2019														
% Fundo	0,54	0,51	0,47	0,52	0,55	0,47	0,57	0,50	0,45	0,29	0,10	0,37	5,47	832,41
% CDI	99,91	103,82	99,23	99,65	100,55	100,35	101,21	99,79	96,44	60,17	25,53	97,92	91,59	104,81
2020														
% Fundo	0,38	0,29	-1,74	-1,66	0,23	0,48	0,26	0,24	0,28	0,17	0,16	0,18	-0,75	825,44
% CDI	101,74	99,83	-	-	97,22	223,43	134,50	152,15	175,74	106,50	109,30	108,02	-	100,79
2021														
% Fundo	0,20	0,18	0,23	0,24	0,27	0,34	0,39	0,47	0,48	0,50	0,61	0,79	4,81	869,97
% CDI	130,63	134,79	115,87	116,19	100,65	112,89	110,87	110,24	109,06	104,86	104,43	103,90	109,48	101,24
2022														
% Fundo	0,76	0,80											1,57	885,20
% CDI	103,75	107,35											105,59	101,33

Líquida de taxa de administração e performance, porém não líquida de impostos devidos. Início das atividades em 2/Jul/2001. Patrimônio médio em 12 meses: R$ 672,80 MM.
Este indicador é mera referência econômica e não parâmetro objetivo do fundo.

Performance - Dados atualizados até 25/02/22

Composição do Fundo

Ajuste Swap e BM&F	0,00%
Fundo Investido	3,43%
Oper. Compromissada	52,32%
Títulos Privados	44,17%
Títulos Públicos	0,08%

Patrimônio: R$ 857,06 MM

Perfil Risco x Retorno (R$)

	Desde Início		Últimos 12 meses	
	Fundo	CDI	Fundo	CDI
Retorno Anualizado	11,75%	11,68%	6,06%	5,65%
Desvio Padrão Anualizado	0,41%	0,29%	0,16%	0,16%
Índice de Sharpe[1]	0,16	-	2,53	-
# de meses abaixo de 100% do CDI	19	-	0	-
# de meses acima de 100% do CDI	228	-	12	-
Maior rentabilidade mensal	2,14%	2,08%	0,80%	0,76%
Menor rentabilidade mensal	-1,74%	0,13%	0,23%	0,20%

[1] A taxa livre de risco utilizada é o CDI

BTG Pactual
Capital Markets FI RF

Características Principais

Código Anbima: 091367

CNPJ: 04.501.865/0001-92

ISIN: BRMARKCTF006

Objetivo do Fundo

O FUNDO tem como objetivo manter uma gestão ativa nos mercados de juros, mantendo um perfil de atuação conservador.

Classificação ANBIMA

RF duração livre grau de investimento

Administrador

BTG Pactual Servicos Financeiros S/A DTVM

Gestor

BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S/A DTVM

Movimentações

INICIAL: R$ 500,00;
MOVIMENTAÇÃO MÍNIMA: R$ 100,00;
SALDO MÍNIMO: R$ 100,00

Público Alvo

O FUNDO destina-se a receber aplicações de investidores pessoas físicas e/ou jurídicas em geral, bem como de fundos de investimento (individualmente, apenas "Cotista", e quando tomados coletivamente denominados "Cotistas").

Taxa de Administração

0,25% A.A. SOBRE O PATRIMÔNIO LÍQUIDO DO FUNDO, APROPRIADA DIARIAMENTE NO VALOR DA QUOTA.

Prêmio de Performance

NÃO HÁ.

I.R.

RETIDO NA FONTE, SEMESTRALMENTE, NO ÚLTIMO DIA ÚTIL DOS MESES DE MAIO E NOVEMBRO, APLICANDO-SE A ALÍQUOTA DE 15%. NO RESGATE É APLICADA A ALÍQUOTA COMPLEMENTAR, EM FUNÇÃO DO PRAZO DA APLICAÇÃO, CONFORME DESCRITO ABAIXO:

I - 22,5% EM APLICAÇÕES COM PRAZO DE ATÉ 180 DIAS;
II - 20% EM APLICAÇÕES COM PRAZO DE 181 DIAS ATÉ 360 DIAS;
III - 17,5% EM APLICAÇÕES COM PRAZO DE 361 DIAS ATÉ 720 DIAS;
IV - 15% EM APLICAÇÕES COM PRAZO ACIMA DE 720 DIAS.

NÃO HÁ GARANTIA DE QUE ESTE FUNDO TERÁ O TRATAMENTO TRIBUTÁRIO PARA FUNDOS DE LONGO PRAZO.

Carência

LIQUIDEZ DIÁRIA.

Aplicações

CHEQUE OU DOC: ATÉ ÀS 15:30H. TED: ATÉ ÀS 15:30H, MEDIANTE CONSULTA À ADMINISTRADORA.
QUOTA DE D+0 DIAS ÚTEIS DA EFETIVA DISPONIBILIDADE DOS RECURSOS.

Resgates

CHEQUE OU DOC: ATÉ ÀS 15:30H. TED: ATÉ ÀS 15:30H, MEDIANTE CONSULTA À ADMINISTRADORA.
QUOTA DE D+0 DIAS ÚTEIS, RECURSOS EM D+0 DIAS ÚTEIS.

Este Fundo utiliza estratégias com derivativos como parte integrante de sua política de investimento. Tais estratégias, da forma como são adotadas, podem resultar em significativas perdas patrimoniais para seus quotistas.

Este fundo poderá adquirir títulos de responsabilidade de emissores privados, em montante superior a 50% (cinqüenta por cento) de seu patrimônio líquido e, portanto, está sujeito a risco de perda substancial de seu patrimônio líquido em caso de eventos que acarretem o não pagamento dos ativos integrantes de sua carteira, inclusive por força de intervenção, liquidação, regime de administração temporária, falência, recuperação judicial ou extrajudicial dos emissores responsáveis pelos ativos do fundo.

O Regulamento e a Lâmina de informações essenciais do fundo podem ser encontrados no site:
https://www.btgpactual.com/home/AssetManagement.aspx/AdministracaoFiduciaria